

Integrarea numerică

Prof.dr.ing. Gabriela Ciuprina

Universitatea "Politehnica" București, Facultatea de Inginerie Electrică

Suport didactic pentru disciplina *Metode numerice*, 2017-2018

Notes

Cuprins

- 1 Introducere
 - Importanța evaluării integralelor
 - Formularea problemei integrării numerice
 - Idei de calcul numeric
- 2 Integrarea funcțiilor cunoscute prin date
 - Metoda dreptunghiurilor
 - Metoda trapezelor
 - Metoda Simpson
- 3 Integrarea funcțiilor cunoscute prin cod
 - Analiza erorii
 - Metoda trapezelor recursive
 - Metoda Romberg

Notes

Importanța evaluării integralelor

- Relații utile pentru evaluarea unor mărimi:

$$u = \int_C \mathbf{E} \cdot d\mathbf{l} \quad \varphi = \int_S \mathbf{B} \cdot d\mathbf{A} \quad q = \int_D \rho dV$$

- Rezolvarea ecuațiilor diferențiale

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \Rightarrow x(t) = x(t_0) + \int_{t_0}^t f(x(t'), t') dt'$$

"rezolvare" = "integrare" (în acest context)

Notes

Formularea problemei - cazul cel mai simplu

Se dă funcția $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ (cunoscută prin date sau prin cod)

Se cere evaluarea numerică a integralei definite

$$\int_a^b f(x) dx$$

unde f este presupusă continuă și mărginită.

Numeric: idei inspirate din matematică.

Notes

Idei de calcul numeric (I)

T. fundamentală a analizei

Dacă f e continuă și F este o primitivă a ei ($F' = f$) atunci

$$\int_a^b f(x) dx = F(b) - F(a)$$

În problemele reale F nu este cunoscută \Rightarrow aplicarea acestei metode este foarte grea / imposibilă.

Idei de calcul numeric (I)

T. fundamentală a analizei

Dacă f e continuă și F este o primitivă a ei ($F' = f$) atunci

$$\int_a^b f(x) dx = F(b) - F(a)$$

În problemele reale F nu este cunoscută \Rightarrow aplicarea acestei metode este foarte grea / imposibilă.

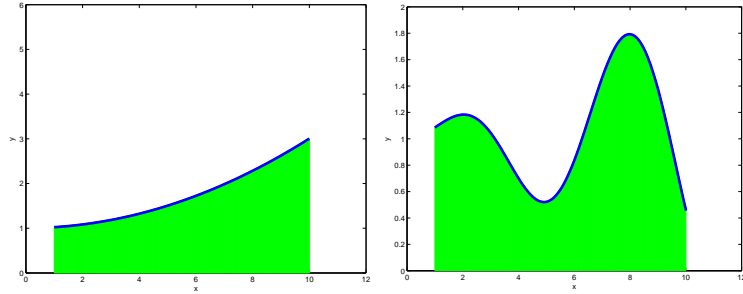
:(

Notes

Notes

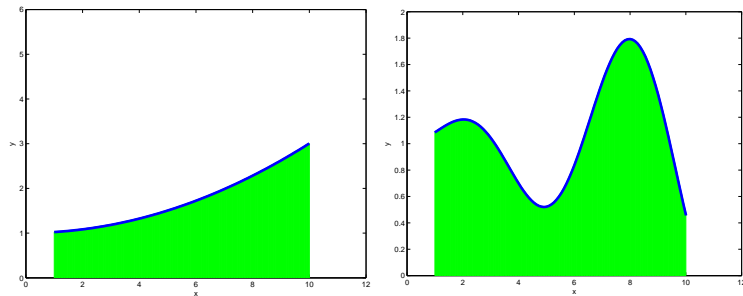
Idei de calcul numeric (II)

Semnificația geometrică a integralei



Idei de calcul numeric (II)

Semnificația geometrică a integralei



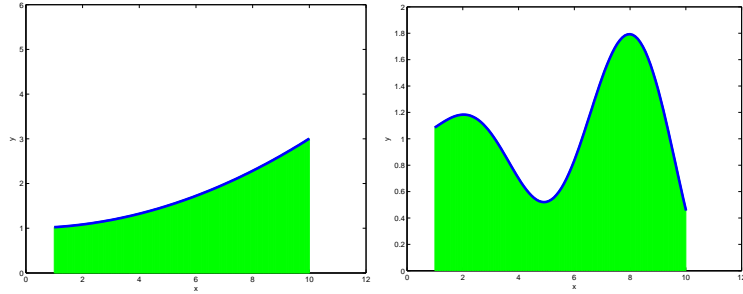
În calculator funcțiile nu au reprezentări continue.

Notes

Notes

Idei de calcul numeric (II)

Semnificația geometrică a integralei



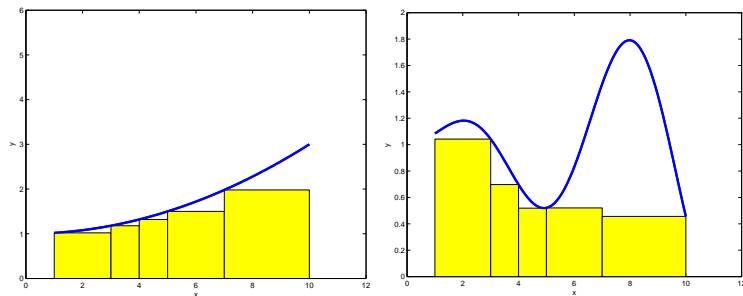
În calculator funcțiile nu au reprezentări continue.
:|

Notes

Idei de calcul numeric (III)

Definiția integralei folosind sume Darboux

Partiția $\mathcal{P} : a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b$

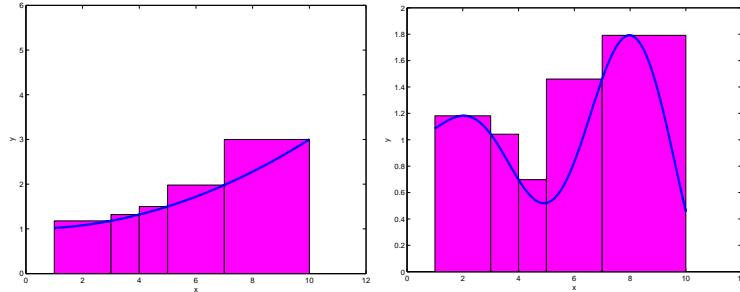


Notes

Idei de calcul numeric (III)

Definiția integralei folosind sume Darboux

Partiția $\mathcal{P} : a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b$



Idei de calcul numeric (III)

Definiția integralei folosind sume Darboux

Partiția $\mathcal{P} : a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b$

$$m_i = \inf\{f(x) : x_i \leq x \leq x_{i+1}\} \Rightarrow L(f, \mathcal{P}) = \sum_{i=0}^{n-1} m_i(x_{i+1} - x_i)$$

$$M_i = \sup\{f(x) : x_i \leq x \leq x_{i+1}\} \Rightarrow U(f, \mathcal{P}) = \sum_{i=0}^{n-1} M_i(x_{i+1} - x_i)$$

$$L(f, \mathcal{P}) \leq \int_a^b f(x) dx \leq U(f, \mathcal{P})$$

Dacă $\inf_{\mathcal{P}} U(f, \mathcal{P}) = \sup_{\mathcal{P}} L(f, \mathcal{P})$ atunci această valoare este integrala (Riemann). \therefore

T. Orice funcție continuă, mărginită, definită pe un domeniu închis este integrabilă Riemann.

Notes

Notes

Idei de calcul numeric (recap.)

Metodele de integrare numerică

- Sunt inspirate de metodele care calculează **arii**;
- Cea mai simplă metodă - aria e aproximată de o reuniune de dreptunghiuri.

$f \approx g$, unde g este constantă pe porțiuni și

$$\int_a^b f(x) dx \approx \int_a^b g(x) dx$$

- Aproximări mai rafinate pentru g pot conduce la rezultate mai bune.

Idei de calcul numeric

Algoritmii depind de modul în care este definită funcția:

- **printr-un tabel de valori**

$$\{x_k, y_k = f(x_k)\}, \quad k = 0, n$$

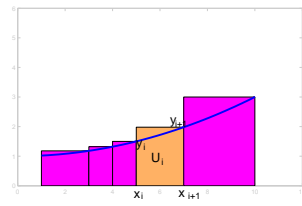
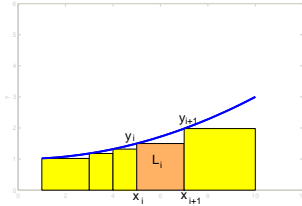
- **prin cod**

$f(x)$ poate fi evaluat în orice x din domeniul de definiție.

Notes

Notes

Metoda dreptunghiurilor - Ideea



$$L_i = (x_{i+1} - x_i) * \min(y_i, y_{i+1})$$

$$U_i = (x_{i+1} - x_i) * \max(y_i, y_{i+1})$$

$$L = \sum_{i=0}^{n-1} L_i$$

$$U = \sum_{i=0}^{n-1} U_i$$

Metoda dreptunghiurilor - Algoritm

```
functie integrala_dreptunghi(n,x,y)
; calculează integrala numerică prin metoda dreptunghiurilor
intreg n
tablou_real x[n], y[n] ; tabelul de valori, indici de la 0
...
L = 0
U = 0
pentru i = 0, n - 1
    m_i = min(y_i, y_{i+1})
    M_i = max(y_i, y_{i+1})
    h = x_{i+1} - x_i
    L = L + m_i * h
    U = U + M_i * h
val.L = L
val.U = U
intoarce val
```

Notes

Notes

Metoda dreptunghiurilor - Algoritm

```
functie integrala_dreptunghi(n,x,y)
; calculează integrala numerică prin metoda dreptunghiurilor
întreg n
tablou_real x[n], y[n] ; tabelul de valori, indici de la 0
...
L = 0
U = 0
pentru i = 0, n - 1
    m_i = min(y_i, y_{i+1})
    M_i = max(y_i, y_{i+1})
    h = x_{i+1} - x_i
    L = L + m_i * h
    U = U + M_i * h
...
val.L = L
val.U = U
întoarce val
```

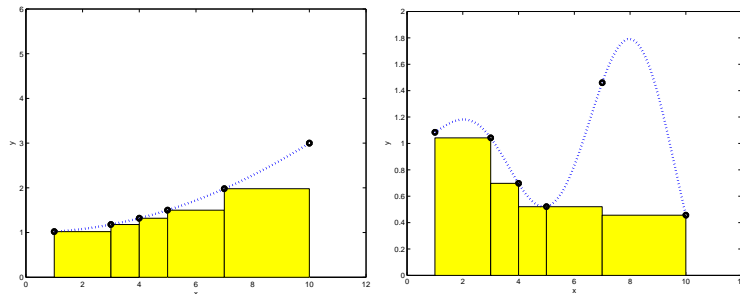
$T = O(5n)$ $M = O(2n)$

Notes

Metoda dreptunghiurilor - Pe scurt

În metoda dreptunghiurilor f este aproximată cu o funcție g constantă pe porțiuni care încadrează inferior/superior funcția.
Variante mai bune

- g este liniară pe porțiuni - metoda trapezelor;
- g parabolă pe porțiuni - metoda Simson



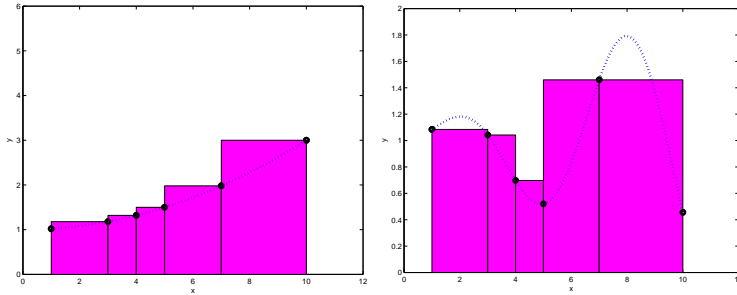
Notes

Metoda dreptunghiurilor - Pe scurt

În metoda dreptunghiurilor f este aproximată cu o funcție g constantă pe porțiuni care încadrează inferior/superior funcția.

Variante mai bune

- g este liniară pe porțiuni - metoda trapezelor;
- g parabolă pe porțiuni - metoda Simson



Dreptunghiuri - U

Gabriela Ciuprina

Integrarea numerică

12/35

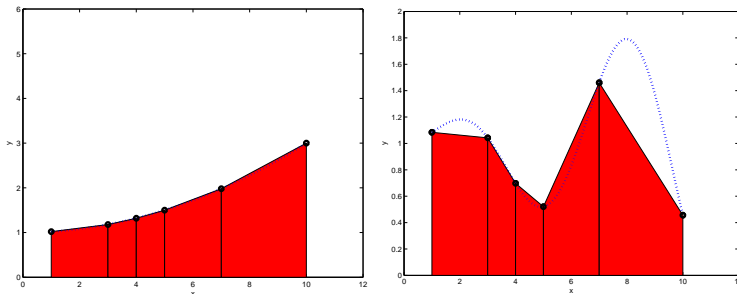
Notes

Metoda dreptunghiurilor - Pe scurt

În metoda dreptunghiurilor f este aproximată cu o funcție g constantă pe porțiuni care încadrează inferior/superior funcția.

Variante mai bune

- g este liniară pe porțiuni - metoda trapezelor;
- g parabolă pe porțiuni - metoda Simson



Trapeze

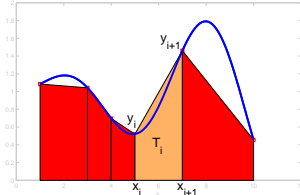
Gabriela Ciuprina

Integrarea numerică

12/35

Notes

Metoda trapezelor - Ideea



$$T_i = \frac{1}{2}(y_i + y_{i+1})(x_{i+1} - x_i)$$

$$T = \sum_{i=0}^{n-1} T_i$$

$$T = \frac{1}{2} \sum_{i=0}^{n-1} (y_i + y_{i+1})(x_{i+1} - x_i)$$

Obs: $T = (L + U)/2$

Metoda trapezelor - Ideea

$$T = \frac{1}{2} \sum_{i=0}^{n-1} (y_i + y_{i+1})(x_{i+1} - x_i)$$

În cazul unui pas echidistant $x_{i+1} - x_i = h, \forall i = 0, \dots, n-1$:

$$\begin{aligned} T &= \frac{h}{2} \sum_{i=0}^{n-1} (y_i + y_{i+1}) = \frac{h}{2} \left(\sum_{i=0}^{n-1} y_i + \sum_{i=0}^{n-1} y_{i+1} \right) = \\ &= \frac{h}{2} \left(\sum_{i=0}^{n-1} y_i + \sum_{i=1}^n y_i \right) = \frac{h}{2} \left(y_0 + \sum_{i=1}^{n-1} y_i + \sum_{i=1}^{n-1} y_i + y_n \right) = \\ &= h \left(\frac{1}{2} y_0 + \sum_{i=1}^{n-1} y_i + \frac{1}{2} y_n \right) \end{aligned} \quad (1)$$

Notes

Notes

Metoda trapezelor - Pe scurt

Integrala numerică este o combinație liniară a valorilor funcției.

În metoda trapezelor coeficienții sunt:

$$y_0 \quad y_1 \quad y_2 \quad \dots \quad y_{n-2} \quad y_{n-1} \quad y_n$$

$$\frac{h}{2} \quad h \quad h \quad \dots \quad h \quad h \quad \frac{h}{2}$$

Formulele de integrare numerică se mai numesc și *reguli de cuadratură*.

Metoda trapezelor - Algoritm

```
funcție integrala_trz(n,x,y)
; calculează integrala numerică prin metoda trapezelor
întreg n
tablou_real x[n], y[n] ; tabelul de valori, indici de la 0
...
T = 0
pentru i = 0, n - 1
    h = xi+1 - xi
    T = T + (yi + yi+1)h
•
întoarce T
```

Notes

Notes

Metoda trapezelor - Algoritm

```
funcție integrala_trz(n,x,y)
; calculează integrala numerică prin metoda trapezelor
întreg n
tablou_real x[n], y[n]          ; tabelul de valori, indici de la 0
...
T = 0
pentru i = 0, n - 1
    h = xi+1 - xi
    T = T + (yi + yi+1)h
•
întoarce T
```

T = O(4n) M = O(2n)

Metoda trapezelor - Algoritm

```
funcție integrala_trz_uniform(n,x,y)
; calculează integrala numerică prin metoda trapezelor, pas echidistant
întreg n
tablou_real x[1], y[n]          ; tabelul de valori, indici de la 0
...
T = (y0 + yn)/2
h = x1 - x0
pentru i = 1, n - 1
    T = T + yi
•
întoarce Th
```

Notes

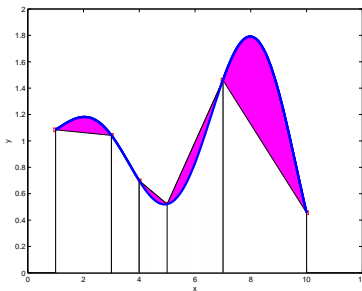
Notes

Metoda trapezelor - Algoritm

```
funcție integrala_trz_uniform(n,x,y)
; calculează integrala numerică prin metoda trapezelor, pas echidistant
întreg n
tablou_real x[1], y[n]      ; tabelul de valori, indici de la 0
...
 $T = (y_0 + y_n)/2$ 
 $h = x_1 - x_0$ 
pentru  $i = 1, n - 1$ 
     $T = T + y_i$ 
•
întoarce Th
```

$T = O(n)$ $M = O(n)$

Metoda trapezelor - Eroarea de trunchiere



- *locală* - pe fiecare interval;
- *globală* - pe întreg domeniul.

Notes

Notes

Metoda trapezelor - Eroarea de trunchiere

Eroarea **locală** absolută:

$$e_{\text{loc}} = \int_{x_k}^{x_{k+1}} f(x) dx - \int_{x_k}^{x_{k+1}} g(x) dx \quad (2)$$

$$e_{\text{loc}} = \int_{x_k}^{x_{k+1}} (f(x) - g(x)) dx = \int_{x_k}^{x_{k+1}} e_{\text{interp}}(x) dx$$

$$e_{\text{interp}}(x) = \frac{f''(\zeta)}{2}(x - x_k)(x - x_{k+1})$$

$$e_{\text{loc}} = \frac{f''(\zeta)}{2} \int_{x_k}^{x_{k+1}} (x - x_k)(x - x_{k+1}) dx = -\frac{f''(\zeta)}{12}(x_{k+1} - x_k)^3$$

$$|e_{\text{loc}}| \leq Ch^3$$

unde $h = x_{k+1} - x_k$

$$|e_{\text{loc}}| = O(h^2)$$

19/35

Notes

Metoda trapezelor - Eroarea de trunchiere

Eroarea **globală** absolută:

$$e_g = \int_a^b f(x) dx - \int_a^b g(x) dx \quad (3)$$

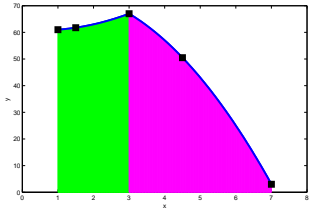
$$e_g = \int_a^b (f(x) - g(x)) dx = \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_k}^{x_{k+1}} (f(x) - g(x)) dx = \sum_{k=0}^{n-1} e_{\text{loc},k}$$

$$|e_g| \leq nCh^3 = \frac{b-a}{h} Ch^3 = O(h^2)$$

20/35

Notes

Metoda Simpson - Ideea



$$S_i = \int_{x_{i-1}}^{x_{i+1}} g(x) dx$$

unde g este polinomul de interpolare locală de ordin 2.

$$S = S_1 + S_3 + \dots + S_{n-1}$$

Numărul de puncte din tabel trebuie să fie impar.

Metoda Simpson - Pe scurt

În cazul unui pas echidistant, se demonstrează că

$$S_i = h \left(\frac{1}{3} y_{i-1} + \frac{4}{3} y_i + \frac{1}{3} y_{i+1} \right)$$

⇒

$$y_0 \quad y_1 \quad y_2 \quad y_3 \quad y_4 \quad \dots \quad y_{n-2} \quad y_{n-1} \quad y_n$$

$$\frac{h}{3} \quad \frac{4h}{3} \quad \frac{2h}{3} \quad \frac{4h}{3} \quad \frac{2h}{3} \quad \dots \quad \frac{2h}{3} \quad \frac{4h}{3} \quad \frac{h}{3}$$

$$|e_g| = O(h^4)$$

OBS: dacă funcția e definită prin cod, este mai eficient să ajungem la o astfel de eroare folosind extrapolarea Richardson.

Notes

Notes

Metoda trapezelor - eroare

Pasul de integrare poate fi ales de utilizator.

- Eroarea globală de trunchiere $O(h^2) \Rightarrow$ scade atunci când h scade;
- Dar rotunjirile?

Metoda trapezelor - eroare

Dacă pp. $e_{y_k}/y_k < \text{eps}$ și $e_h = 0$ atunci

$$\begin{aligned} e_r &\leq h \left(1/2|e_{y_0}| + 1/2|e_{y_n}| + \sum_{k=1}^n |e_{y_k}| \right) \leq \\ &\leq h \left(1/2|y_0|\text{eps} + 1/2|y_n|\text{eps} + \sum_{k=1}^n |y_k|\text{eps} \right) \leq \\ &\leq ChnM_0 \text{eps} = C(b-a)M_0 \text{eps} = O(1) \end{aligned}$$

Integrala este mult mai robustă decât derivarea numerică.

Nu numai că erorile de trunchiere sunt mai mici pentru același tip de funcție de interpolare (lpp), dar și efectul erorilor de rotunjire este mai mic.

Notes

Notes

Metoda trapezelor - efort de calcul

În cazul funcțiilor date prin cod

operația de referință este evaluarea funcției de integrat.

- Numărul de evaluări de funcții crește cu atunci când h scade.

Trebuie făcut un **compromis între pasul de integrare și efortul de calcul**. Notasem:

$$T = \frac{h}{2} (y_0 + y_n) + h \sum_{i=1}^{n-1} y_i$$

E mai bine să notăm acum:

Metoda trapezelor - efort de calcul

În cazul funcțiilor date prin cod

operația de referință este evaluarea funcției de integrat.

- Numărul de evaluări de funcții crește cu atunci când h scade.

Trebuie făcut un **compromis între pasul de integrare și efortul de calcul**. Notasem:

$$T = \frac{h}{2} (y_0 + y_n) + h \sum_{i=1}^{n-1} y_i$$

E mai bine să notăm acum:

$$T = \frac{h}{2} (f(x_0) + f(x_n)) + h \sum_{i=1}^{n-1} f(x_i)$$

Notes

Notes

Metoda trapezelor - efort de calcul

În cazul funcțiilor date prin cod

operația de referință este evaluarea funcției de integrat.

- Numărul de evaluări de funcții crește cu atunci când h scade.

Trebuie făcut un **compromis între pasul de integrare și efortul de calcul**. Notasem:

$$T = \frac{h}{2} (y_0 + y_n) + h \sum_{i=1}^{n-1} y_i$$

E mai bine să notăm acum:

$$T(f, \mathcal{P}) = \frac{h}{2} (f(x_0) + f(x_n)) + h \sum_{i=1}^{n-1} f(x_i)$$

Notes

Metoda trapezelor - efort de calcul

În cazul funcțiilor date prin cod

operația de referință este evaluarea funcției de integrat.

- Numărul de evaluări de funcții crește cu atunci când h scade.

Trebuie făcut un **compromis între pasul de integrare și efortul de calcul**. Notasem:

$$T = \frac{h}{2} (y_0 + y_n) + h \sum_{i=1}^{n-1} y_i$$

E mai bine să notăm acum:

$$T(f, \mathcal{P}) = \frac{h}{2} (f(x_0) + f(x_n)) + h \sum_{i=1}^{n-1} f(x_i)$$

unde \mathcal{P} este o partiție a domeniului: $a = x_0, x_1, \dots, x_n = b$

Notes

Trapeze recursive - Ideea

- Se înjumătățesc intervalele până când valoarea integralei nu se mai modifică;
- La fiecare pas se evaluează funcția numai în punctele în care nu a mai fost evaluată.

Partiția inițială: $\mathcal{P}_0: a = x_0, x_1 = b$

Pasul inițial: $h_0 = b - a$

Prima aproximație a integralei:

$$T_0 = T(f, \mathcal{P}_0) = \frac{b-a}{2}(f(a) + f(b))$$

Trapeze recursive - Ideea

$$\mathcal{P}_1: a = x_0, x_1^{(1)} = (a+b)/2, x_2 = b$$
$$h_1 = (b-a)/2$$

$$T_1 = T(f, \mathcal{P}_1) = \frac{h_1}{2}(f(a) + f(b)) + h_1 f(x_1^{(1)})$$

o evaluare nouă

$$\mathcal{P}_2: a = x_0, x_1^{(2)}, x_2^{(2)}, x_3^{(2)}, x_4 = b$$
$$h_2 = (b-a)/2^2$$

$$T_2 = T(f, \mathcal{P}_2) = \frac{h_2}{2}(f(a) + f(b)) + h_2 \sum_{i=1}^3 f(x_i^{(2)})$$

două evaluari noi

Notes

Notes

Trapeze recursive - Ideea

$$\mathcal{P}_m: a = x_0, x_1^{(m)}, x_2^{(m)}, \dots, x_{2^m} = b$$
$$h_m = (b - a)/2^m$$

$$T_m = T(f, \mathcal{P}_m) = \frac{h_m}{2}(f(a) + f(b)) + h_m \sum_{i=1}^{2^m-1} f(x_i^{(m)})$$

Algoritmul se bazează pe următoarea relație de recurență:

$$T_m = \frac{1}{2}T_{m-1} + h_m \sum_{i=1}^{2^m-1} f(a + (2i - 1)h_m)$$

$T_0, T_1, T_2, T_3, \dots$

și se oprește atunci când diferența dintre două aproximații consecutive este mai mică decât o toleranță impusă.

Trapeze recursive - Alte notații

Alte notații, utile pentru ce urmează:

$$T_m = R(m, 0)$$

(R - de la Romberg)

$$R(m, 0) = \frac{1}{2}R(m - 1, 0) + h \sum_{i=1}^{2^m-1} f(a + (2i - 1)h)$$

unde $h = (b - a)/2^m$.

Notes

Notes

Extrapolarea Richardson - Ideea

La trapeze, eroarea globală este $O(h^2)$: $I(h) = I_0 + Ch^2$

- 1 Evaluăm integrala pentru h_0 :

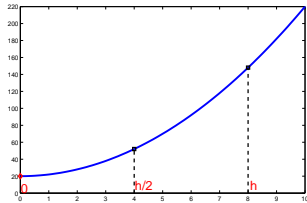
$$I_1 = I_0 + Ch_0^2$$

- 2 Reducem pasul la jumătate:

$$I_2 = I_0 + C \left(\frac{h_0}{2} \right)^2$$

⇒

$$I_0 = \frac{4I_2 - I_1}{3}$$



Extrapolarea Richardson

Obs:

- Formula care se obține este exact formula Simpson (nr. impar de noduri).
- I_0 nu este chiar valoarea exactă (nici într-o aritmetică precisă), deoarece se demonstrează că eroare de trunchiere este mai precis

$$I(h) = I_0 + c_2h^2 + c_4h^4 + c_6h^6 + \dots$$

Mai corect este să aplicăm extrapolarea Richardson, așa cum am procedat la derivare.

Notes

Notes

Extrapolare Richardson - Ideea generală

Se poate aplica pentru aproximarea cu acuratețe din ce în ce mai mare a unei mărimi I , pentru care există o funcție $\varphi(h)$. a.î.

- $I = \lim_{h \rightarrow 0} \varphi(h)$
- $\varphi(h)$ poate fi evaluată pentru orice h ;
- are loc proprietatea:

$$\varphi(h) = I - \sum_{k=1}^{\infty} a_{2k} h^{2k} \quad (4)$$

unde coeficienții a_{2k} nu sunt cunoscuți.

Se alege un h potrivit și se calculează numerele

$$R(i, 0) = \varphi(h/2^i), \quad i = 0, \dots, n. \quad (5)$$

Extrapolare Richardson - Ideea generală

$R(i, 0)$ reprezintă estimări ale lui I , dar estimări mai precise se pot obține prin extrapolare Richardson.
Se demonstrează că [Cheney]:

$$R(i, j) = R(i, j-1) + (R(i, j-1) - R(i-1, j-1))/(4^j - 1), \quad j = 0, \dots, i. \quad (6)$$

$$\begin{matrix} R(0, 0) \\ R(1, 0) & R(1, 1) \\ R(2, 0) & R(2, 1) & R(2, 2) \\ \vdots & \vdots & \vdots \\ R(n, 0) & R(n, 1) & R(n, 2) & \dots & R(n, n) \end{matrix} \quad (7)$$

Notes

Notes

Metoda Romberg

Metoda Romberg = extrapolare Richardson pentru evaluarea integralelor Se dau:

- funcția dată prin cod f ;
- informația despre ordinul erorii la care dorim să ajungem n .

...

pentru $i = 0, n$

$R_{i,0} = \dots$; apel trapeze

pentru $j = 1, i$

$$R_{i,j} = R_{i,j-1} + (R_{i,j-1} - R_{i-1,j-1}) / (4^j - 1)$$

•

$$h = h/2$$

•

...

Lectură recomandată

Obligatoriu:

- Cap.8 din

[1] Gabriela Ciuprina, Mihai Rebican, Daniel Ioan - Metode numerice in ingineria electrica - Indrumar de

laborator pentru studentii facultatii de Inginerie electrica, Editura Printech, 2013, disponibil la

http://mn.lmn.pub.ro/indrumar/IndrumarMN_Printech2013.pdf

Facultativ:

- Cap 5 din

[Cheney] Ward Cheney and David Kincaid, Numerical Mathematics and Computing, Brooks/Cole publishing Company,2000.

<http://www.physics.brocku.ca/Courses/5P10/References/cheneykincaid.pdf>

Notes

Notes
